

纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第二号)

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会证监许可[2013]262号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会不对本基金募集的合规性进行核准，并不对该基金的价格和收益作出实质性判断或保证，也不对投资于本基金的风险进行提示。

本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场价格波动等因素产生波动，投资人投资于本基金前，请认真阅读本招募说明书，充分认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量及申购金额等投资安排进行独立决策，承担本基金投资可能呈现出的各类风险。

投资人本基金可能遇到的主要风险包括：（1）本基金特有的风险，基金投资所标的股票与股票市场的价格波动风险、指的指数变动的风险、基金投资组合回报与标的指数的回报偏离度的风险、指的指数表现的风险、基金经理人为代理人代理投资人买卖股票的风险、基金份额首次交易场外交易价格折溢价的风险、退市风险、申购失败的风险、赎回失败的风险、投资人参与CPOY购买投资组合的风险和OPIVP计算错误的风险、第一方机构服务的风险、管理风险等；（2）投资风险，主要包括市场风险、行业风险、区域风险、政策风险、操作风险等；（3）不可抗力风险等；等等。

本基金投资于指数成分股，备选成份股的资产不高于基金总资产的90%。本基金在指数成分股的指数成分股，指的风格与混合型基金、债券基金与货币市场基金、本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数一致的指数风险，与股票市场的相似的风险收益特征。

基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中涉及的“托管费”指本基金信息已经本基金托管人复核，本招募说明书中所载内容截止日为2017年10月31日，投资组合为2017年3季度报告，有关财务数据和净值数据截止日为2017年6月30日。

一、基金的基本情况

纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金

二、基金的类型和存续期限

1.基金的类别:境外股票型基金

2.基金的投资方式:交易型开放式

3.基金存续期间:不定期

三、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

四、投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的的指数的公募基金（包括ETF）、依法发行或上市的其他股票、固定收益类资产、银行存款、货币市工具、股票质押等衍生品种、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金净资产的90%。

五、投资策略

本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重的比例构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如成为股票停牌期、停牌股被变更为成份股、股票重估由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金无法按照标的指数成份股及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场条件下，本基金的风险控制目标是实现对日跟踪偏离度的绝对值不超过±0.2%，年跟踪误差不超过2%，如因标的指数编制规则调整或其它因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

另外，本基金基于流动性管理的需要，将投资于与本基金有相关的投资目标、投资策略，且以本基金的标的指数为投资标的的指数型公募基金（包括ETF）。同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金将在条件允许的情况下，开展证券投资业务以及投资于货币市场基金等金融产品，以降低跟踪误差风险。

本基金投资于商品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合紧密地跟踪标的指数，不得直接投资于商品期货、期权和杠杆工具放大资金的投资。

未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率（经汇率调整后的总收益指数收益率）。本基金的业绩指标为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）。

纳斯达克100 指数于1988年1月31 日发布，涵盖了纳斯达克股票交易市场上100只市值最大的非金融上市公司，反映了科技、工业、零售、电信、生物技术、娱乐、传媒、纺织品公司等行业的整体走势。该指数具有广泛的分散性，赢得了投资者和分析专家的广泛认同。

本基金的业绩指标为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）。

七、风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数一致的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

八、基金管理人的董事会、监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金所载资料的真实性、准确性、完整性和完整性承担连带责任。

基金管理人在中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金组合报告所载数据截至2017年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

九、报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产总额: 295,928,865.16 元

其中:银行存款和结算备付金: 21,206,794.40 元

其中:应收证券清算款: 7,42 元

其中:应付证券清算款: 6,090,000.00 元

其中:应付赎回款: 2,13 元

其中:应付交易费用: 2,376,267.80 元

其中:应付税费: 0.06 元

其中:应付利息: 100.00 元

其中:应付买入返售金融资产: - 元

其中:应付卖出回购金融资产: - 元

其中:应付票据: - 元

其中:应付定期存款: - 元

其中:应付保证金: - 元

其中:应付交易保证金: - 元

其中:应付申购款: - 元

其中:应付赎回款: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: - 元

其中:应付定期存款手续费: - 元

其中:应付定期存款利息: - 元

其中:应付定期存款赎回利息: